BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C.,22 de abril de 2019 No. 049

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A LO ESTABLECIDO EN EL ARTÍCULO 4.5.3.3. DE LA CIRCULAR ÚNICA DE LA CÁMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA S.A. - CRCC S.A.

Cualquier aclaración que requiera, favor comunicarse con Subgerencia de Riesgos y Operaciones de la CRCC S.A. vía telefónica al número 3277000 opción 1 o a través de la cuenta de correo electrónico: operacionescrcc@camaraderiesgo.com.co.

A. GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES

En caso de que el valor de la Posición Abierta neta de una Cuenta, ya sea de Registro de la Posición Propia o de un Tercero Identificado, y en un determinado Activo objeto de las Operaciones Repo supere el 100% del Volumen Medio Diario será considerada como una Gran Posición, por lo tanto, se entiende que el horizonte de tiempo (días) necesario para cerrar dicha posición aumenta, según lo muestra la siguiente tabla:

% Sobre el Volumen Medio Diario	Horizonte de Tiempo (días)
Hasta un 100%	3
Hasta un 200%	4
Mayor a un 300%	5

Por tal razón los parámetros para el cálculo de la Garantía por Posición y el Riesgo en situación de estrés se incrementarán de acuerdo al incremento del horizonte de tiempo (días) necesario para cerrar la posición según se muestra en la siguiente tabla:

% Sobre el Volumen Medio Diario	Horizonte de Tiempo (días)	% de incremento en la Garantía por Posición.
Entre un 100% y 150%	3	22%
Entre un 150% y 200%	4	41%
Mayor a un 200%	5	58%

El incremento de las fluctuaciones y de las fluctuaciones de estrés en el caso de existir una Gran Posición se hará efectivo en el siguiente día hábil de registrada dicha posición.

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 23 de abril hasta el 29 de abril de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	**VMD Efectivo**	**VMD acciones**
BCOLOMBIA	10.461.000.000	254.646
CELSIA	1.437.000.000	318.563
CEMARGOS	6.760.000.000	833.544
CORFICOLCF	2.987.000.000	114.898

ECOPETROL	79.941.000.000	26.383.060
EEB	3.751.000.000	1.781.733
EXITO	4.442.000.000	317.258
GRUPOARGOS	4.830.000.000	270.436
GRUPOSURA	11.101.000.000	314.310
ISA	6.231.000.000	382.273
NUTRESA	3.393.000.000	131.915
PFAVAL	8.951.000.000	6.832.638
PFBCOLOM	77.669.000.000	1.874.260
PFDAVVNDA	4.021.000.000	101.741
PFGRUPSURA	2.961.000.000	86.831
ICOLCAP	7.329.000.000	457.106

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías